

工行金融市场：外币利率市场上周概览

(2024年3月18日-3月22日)

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格上涨，10年期美国国债收益率较前周下行10.8BP，上周收于4.198%。
- 德国国债价格上涨，10年期德国国债收益率较前周下行11.9BP，上周收于2.323%。

表1：主要国家政府债券收益率变动

美国国债	收盘收益率 (%)	较前周 (BP)	较上月末 (BP)	较去年末 (BP)
2年	4.589	-13.9	-3.0	33.9
5年	4.182	-14.4	-6.3	33.5
10年	4.198	-10.8	-5.2	31.9
30年	4.378	-5.1	-0.1	35.0
德国国债				
2年	2.827	-11.9	-7.4	42.3
5年	2.333	-13.5	-9.8	38.5
10年	2.323	-11.9	-8.8	29.9
30年	2.494	-8.6	-4.5	23.1

数据来源：彭博

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率下行，10年期美元利率掉期率较前周下行9.15BP，上周收于3.8365%。

表 2：美元利率掉期率变动

	收盘收益率(%)	较前周 (BP)	较上月末 (BP)	较去年末 (BP)
2年	4.4796	-14.49	-4.09	41.39
10年	3.8365	-9.15	-3.68	36.25
30年	3.6479	-3.23	-0.22	33.18

数据来源：彭博

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。